

ประกาศ**เรื่อง การเรียกหลักประกันเพิ่ม (Margin Call) และการบังคับล้างสถานะสัญญา (Force Close) ของการซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า**

เพื่อให้การปฏิบัติงานเกี่ยวกับการเป็นตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) สามารถดำเนินการได้อย่างมีประสิทธิภาพ และเพื่อให้ลูกค้าของบริษัททราบเงื่อนไขตามสัญญาแต่งตั้งตัวแทนซื้อขายสัญญาซื้อขายล่วงหน้า บริษัทฯ ขอแจ้งแนวทางปฏิบัติในเรื่องของการวางหลักประกันเพิ่ม (Margin Call) และการล้างสถานะสัญญา (Force Close) ดังนี้

กรณีการเรียกหลักประกันเพิ่ม (Margin Call)

หลังจากบริษัทได้ทำการ Mark to Market ณ สิ้นวันที่ T แล้ว หลักประกันเทียบเท่าเงินสดของลูกค้า (EB) ต่ำกว่าหลักประกันรักษาสภาพ (MMR) แต่ยังคงสูงกว่าระดับหลักประกันปิดฐานระหว่างวัน (FMR) บริษัทฯ จะดำเนินการเรียกให้ลูกค้านำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มในวันที่ T+1 ก่อนตลาดปิดทำการซื้อขายภาคปกติหนึ่งชั่วโมง ซึ่งลูกค้าสามารถเลือกวิธีการตามที่ระบุไว้ท้ายประกาศนี้ (**)

กรณีการบังคับล้างสถานะสัญญา (Force Close) (ยกเว้นลูกค้าประเภทสถาบัน) ให้พิจารณาโดยแบ่งเป็น 2 ช่วงเวลาดังนี้

1. เมื่อตลาดปิดทำการซื้อขายภาคเช้า

หลังจากบริษัทได้ทำการ Mark to Market แล้วหลักประกันเทียบเท่าเงินสดของลูกค้า (EB) ต่ำกว่าระดับหลักประกันปิดฐานระหว่างวัน (FMR) บริษัทฯ จะดำเนินการเรียกให้ลูกค้านำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มเพื่อให้หลักประกันเทียบเท่าเงินสด (EB) กลับมาที่ระดับหลักประกันรักษาสภาพ (MMR) ก่อนตลาดปิดทำการซื้อขายภาคปกติ 1 ชั่วโมงซึ่งลูกค้าสามารถเลือกวิธีการตามที่ระบุไว้ท้ายประกาศนี้(**)

กรณีไม่มีราคาที่ใช้ชำระราคา (Settlement Price) จากตลาดซื้อขายล่วงหน้า ให้ใช้ราคาซื้อขายล่าสุด (Last Price) และกรณีไม่มีราคาซื้อขายล่าสุด (Last Price) ให้ใช้ราคาที่ใช้ชำระราคา (Settlement Price) ของวันทำการก่อนหน้า

2. เมื่อตลาดปิดทำการซื้อขายภาคปกติ

หลังจากบริษัทได้ทำการ Mark to Market แล้ว หลักประกันเทียบเท่าเงินสดของลูกค้า (EB) ต่ำกว่าระดับหลักประกัน ปิดฐานระหว่างวัน (FMR) บริษัทฯ จะดำเนินการเรียกให้ลูกค้านำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มเพื่อให้หลักประกันเทียบเท่าเงินสด (EB) กลับมาที่ระดับหลักประกันรักษาสภาพ (MMR)

ก่อนตลาดปิดทำการซื้อขายภาคเช้า 1 ชั่วโมงของวันทำการถัดไป (T+1) และลูกค้ายังมีหน้าที่ในการนำหลักประกันมาวางเพิ่มให้เกินกว่าระดับหลักประกันเริ่มต้น (IMR) ก่อนตลาดปิดทำการซื้อขายภาคปกติ 1 ชั่วโมงของวันทำการถัดไป (T+1) ซึ่งลูกค้าสามารถเลือกวิธีการตามที่จะระบุไว้ท้ายประกาศนี้ (**)

() ลูกค้าสามารถเลือกวิธีการได้ดังนี้**

1. นำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มทั้งจำนวนเงินที่ถูกเรียก
2. ปิดฐานะสัญญา (Close) หรือสร้างฐานะ (Spread) จนกว่าหลักประกันเทียบเท่าเงินสด (EB) จะมีมูลค่าไม่น้อยกว่าระดับหลักประกันเริ่มต้น (IMR) โดยอ้างอิงฐานะในวันที่ T และไม่ต่ำกว่าจำนวนเงินที่ถูกเรียกให้นำมาวางเป็นหลักประกันเพิ่ม
3. ปิดฐานะสัญญา (Close) หรือสร้างฐานะ (Spread) บางส่วนและนำเงินมาวางเป็นหลักประกันบางส่วน โดยยอดรวมไม่ต่ำกว่าจำนวนเงินที่ถูกเรียกให้นำมาวางเป็นหลักประกันเพิ่ม โดยอ้างอิงจากฐานะในวันที่ T

หลังจากบริษัทได้ดำเนินการเรียกให้ลูกค้านำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่ม ทั้งในกรณีการเรียกหลักประกันเพิ่ม (Margin Call) และในกรณีการบังคับล้างสถานะสัญญา (Force Close) หากปรากฏว่าหลักประกันของลูกค้าเพิ่มขึ้นเกินกว่าหรือเท่ากับ MMR หรือ IMR (แล้วแต่กรณี) โดยลูกค้าไม่ได้ดำเนินการใดๆ ลูกค้ายังคงต้องนำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มตามจำนวนที่ถูกเรียก หากลูกค้าไม่นำเงินมาวางเป็นหลักประกันเพิ่มหรือไม่ดำเนินการอื่นใดตามที่กำหนดข้างต้น บริษัทมีสิทธิบังคับปิดฐานะสัญญาซื้อขายล่วงหน้าฐานะการถือครองของลูกค้าเท่ากับศูนย์ได้ทันที หรือ บริษัทอาจไม่อนุญาตให้ลูกค้าสร้างฐานะสัญญาใหม่เพิ่ม

ทั้งนี้ให้มีผลบังคับตั้งแต่วันที่ 2 กรกฎาคม พ.ศ.2558 เป็นต้นไป

ประกาศ ณ วันที่ 23 มิถุนายน พ.ศ. 2558


(ดร. พิชร สุระจรัส)

กรรมการบริหาร